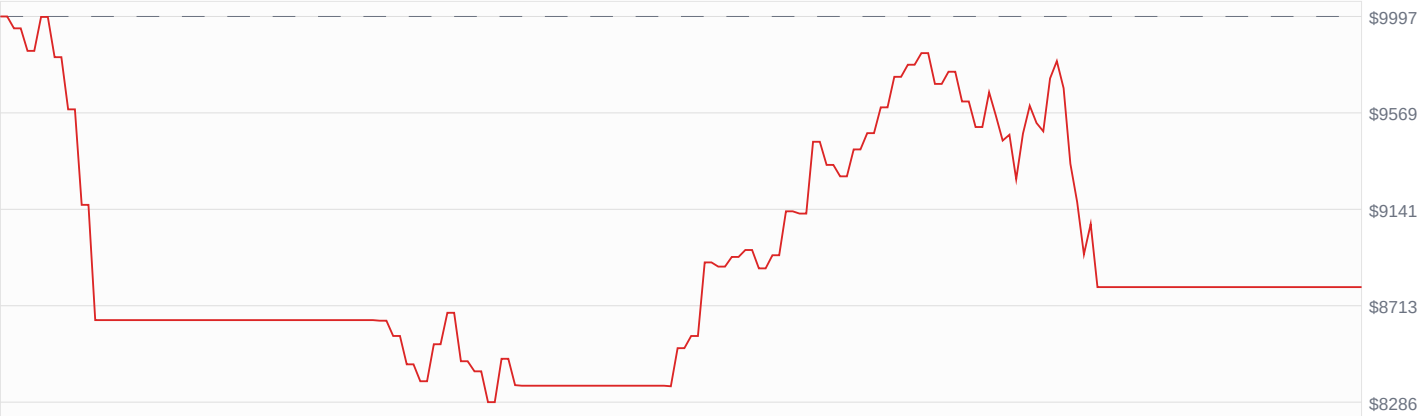




Backtest #31466 · AMZN · EVO\_GG1RSISNIP\_v224

|         |        |          |              |
|---------|--------|----------|--------------|
| ROI     | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| -12.04% | -0.94  | 33.3%    | -17.14%      |

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO\_GG1RSISNIP\_v224 mostró resultados negativos en AMZN con un ROI de -12.04% y Sharpe de -0.94, indicando que el modelo no capturó alpha en esta muestra. La baja tasa de ganancia del 33.3% y el drawdown máximo del 17.14% revelan una falta de consistencia en las señales generadas, con solo 3 operaciones realizadas. Dado el tamaño limitado de trades, la confianza estadística es baja. Se recomienda aumentar el número de trades a al menos 20 para evaluar la robustez del modelo antes de considerar su implementación en producción.

ADDITIONAL METRICS

|                 |           |
|-----------------|-----------|
| CAGR            | -12.04%   |
| Sortino Ratio   | -0.59     |
| Turnover        | 5.28x     |
| Total Trades    | 3         |
| Initial Capital | \$9997.00 |
| Final Capital   | \$8796.05 |